

# 平安大华鑫荣混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>

11.1 备查文件目录.....	58
11.2 存放地点.....	58
11.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华鑫荣混合型证券投资基金	
基金简称	平安大华鑫荣混合	
场内简称	-	
基金主代码	004827	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 23 日	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	56,621,072.43 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	平安大华鑫荣混合 A	平安大华鑫荣混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	004827	004828
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	14,956,741.65 份	41,664,330.78 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过合理配置大类资产和精选投资标的，在严格控制下行风险和保持资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金将采取主动的类属资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合财富（总值）指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款利率×5%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金	
	平安大华鑫荣混合 A	平安大华鑫荣混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安大华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	010-66105798
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105799
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		罗春风	易会满

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	平安大华鑫荣 A	平安大华鑫荣 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	143,473.29	366,438.20
本期利润	-264,991.42	-174,367.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0158	-0.0030
本期加权平均净值利润率	-1.57%	-0.30%
本期基金份额净值增长率	-2.05%	-2.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	-169,980.45	-707,398.20
期末可供分配基金份额利润	-0.0114	-0.0170
期末基金资产净值	14,786,761.20	40,956,932.58
期末基金份额净值	0.9886	0.9830
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.14%	-1.70%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安大华鑫荣混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.18%	0.36%	-0.67%	0.19%	-0.51%	0.17%
过去三个月	-1.47%	0.34%	0.05%	0.18%	-1.52%	0.16%
过去六个月	-2.05%	0.32%	1.11%	0.18%	-3.16%	0.14%
自基金合同	-1.14%	0.25%	2.27%	0.15%	-3.41%	0.10%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

## 平安大华鑫荣混合 C

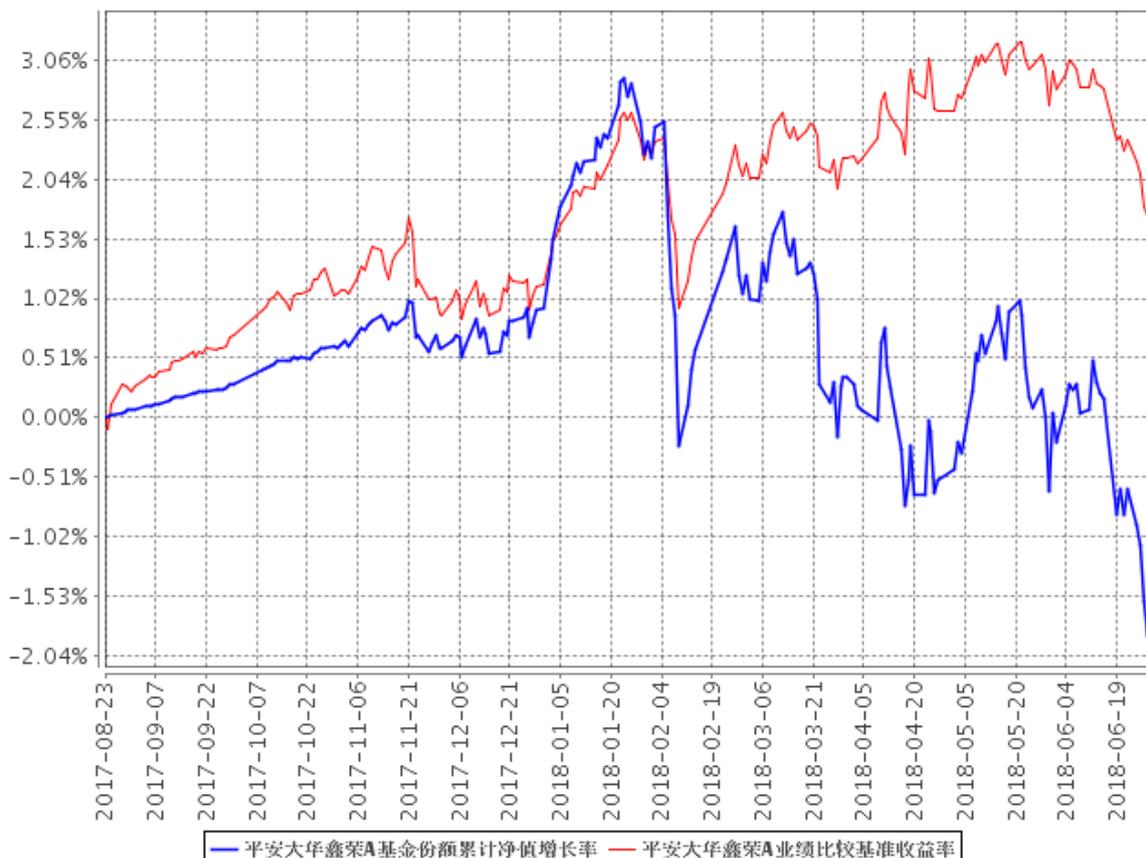
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.24%	0.36%	-0.67%	0.19%	-0.57%	0.17%
过去三个月	-1.61%	0.34%	0.05%	0.18%	-1.66%	0.16%
过去六个月	-2.37%	0.32%	1.11%	0.18%	-3.48%	0.14%
自基金合同生效起至今	-1.70%	0.25%	2.27%	0.15%	-3.97%	0.10%

注：1、中债新综合财富(总值)指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*15%+金融机构人民币活期存款利率\*5%。其中，沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中债新综合财富(总值)指数隶属于中债总指数族分类，该指数成分券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛的指数之一。本基金为偏债混合型基金，通常情况下基金在运作过程中股票资产将在 40%以下调整。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是 15%和 80%。

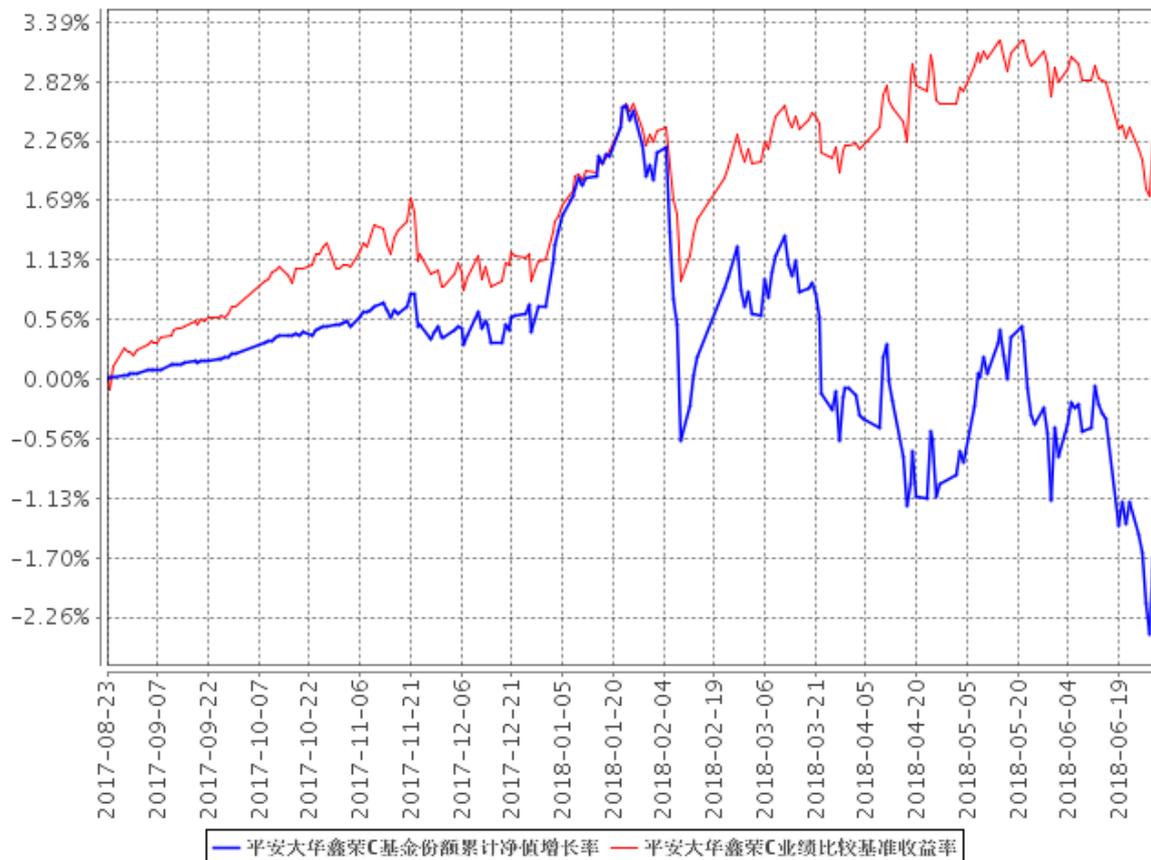
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

平安大华鑫荣A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安大华鑫荣C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2017 年 8 月 23 日正式生效，截至报告期末未满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金未完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安大华基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917号文批准设立。平安大华基金总部位于深圳，注册资本为 3 亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本最高的基金公司之一。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股权 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。平安大华基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2018 年 6 月 30 日，平安大华基金共管理 57 只公募基金，资产管理总规模 2442 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申俊华	平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金经理	2017年8月23日	-	9	申俊华女士，湖南大学金融学博士，曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员。2012年加入平安大华基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。现担任平安大华财富宝货币市场基金、平安大华交易型货币市场基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫荣混合型证券投资基金、平安大华惠悦纯债债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金基金经理。
DANIEL DONGNING	平安大华鑫荣	2017年9月12日	-	13	DANIEL DONGNING SUN 先生，美国籍，北京大学硕

SUN	混合型 证券投资 基金 基金经 理、衍生 品投资 中心投 资执行 总经理			<p>士，美国哥伦比亚大学博士，约翰霍普金斯大学博士后。先后担任瑞士再保险自营交易部量化分析师、花旗集团投资银行高级副总裁、瑞士银行投资银行交易量化总监、德意志银行战略科技部量化服务负责人。2014 年 10 月加入平安大华基金管理有限公司，任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金、平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安大华鑫荣混合型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。</p>
张恒	平安大 华鑫荣 混合型 证券投资 基金 基金经 理	2018 年 1 月 8 日	-	<p>6</p> <p>张恒先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于华泰证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫基金、景顺长城基金，2015 年起在第一创业证券历任投资经理、高级投资经理、投资主办人。2017 年 11 月加入平安大华基金管理有限公司，任固定收益投资部投资经理。现任平安大华鑫荣混合型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华保本混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资</p>

					基金、平安大华惠安纯债债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 上半年，A 股市场发生了明显的变化，风格切换较以前加快，一季度市场的波动幅度加大，去年强势的白马蓝筹在一月份走出强势冲高行情后回落，出现较大幅震荡；同时，中小创等成长股出现部分结构性反弹，部分成长股投资价值逐渐显现；进入二季度后，受国内去杠杆和对美贸易战不断发酵的影响，市场风险偏好下降，包括本基金在内，市场对下半年国内经济形势持谨慎态度，各指数均出现较大幅震荡和下跌，估值回落，一定程度超出市场预期。上半年出于对市场各项风险叠加以及上市公司业绩的面临经济回落和去杠杆考验的担忧，本基金在控制总体仓位的前提下，收紧组合行业和风格暴露，精选防御性个股为主要配置策略，争取超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安大华鑫荣 A 基金份额净值为 0.9886 元，本报告期基金份额净值增长率为 -2.05%；截至本报告期末平安大华鑫荣 C 基金份额净值为 0.9830 元，本报告期基金份额净值增长率为 -2.37%；同期业绩比较基准收益率为 1.11%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内政策底有望探明，去杠杆的节奏也有可能发生变化，但是外部风险依旧，整体经济较上半年难言有大的改观，市场的个股和结构性机会大于整体的系统性机会，本基金的投资也将做相应调整以应对未来市场变化。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，成员由投资管理部门、研究中心、资本市场风控监控室、基金运营部基金会计室及法律合规监察部相关人员组成。基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。

估值委员会的职责主要包括有：制订健全有效的估值政策和程序；定期对估值政策和程序进行评价等；保证基金估值的公平、合理；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；

估值委员会成员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对平安大华鑫荣混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，平安大华鑫荣混合型证券投资基金的管理人——平安大华基金管理有限公司在平安大华鑫荣混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，平安大华鑫荣混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安大华基金管理有限公司编制和披露的平安大华鑫荣混合型证券投资基金 2018 年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安大华鑫荣混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,976,932.85	1,703,047.98
结算备付金		-	81,586.44
存出保证金		1,046.61	6,500.86
交易性金融资产	6.4.7.2	54,766,581.60	179,287,147.40
其中：股票投资		16,067,581.60	21,099,147.40
基金投资		-	-
债券投资		38,699,000.00	158,188,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,371,792.63	1,848,338.39
应收股利		-	-
应收申购款		198.10	99,407.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		60,116,551.79	183,026,028.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,998,878.00	24,648,723.03
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		136,385.94	3,935,191.66
应付管理人报酬		55,981.35	171,769.76
应付托管费		9,330.22	28,628.31
应付销售服务费		17,048.03	62,510.50
应付交易费用	6.4.7.7	16,127.61	20,767.34

应交税费		-	-
应付利息		1,176.94	39,879.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	137,929.92	120,013.47
负债合计		4,372,858.01	29,027,483.71
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	56,621,072.43	152,890,958.89
未分配利润	6.4.7.10	-877,378.65	1,107,585.58
所有者权益合计		55,743,693.78	153,998,544.47
负债和所有者权益总计		60,116,551.79	183,026,028.18

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，平安大华鑫荣 A 基金份额净值 0.9886 元，基金份额总额 14,956,741.65 份；平安大华鑫荣 C 基金份额净值 0.9830 元，基金份额总额 41,664,330.78 份。平安大华鑫荣份额总额合计为 56,621,072.43 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华鑫荣混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		533,597.55	-
1.利息收入		1,210,180.59	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,762.54	-
债券利息收入		1,176,799.10	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,618.95	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		257,894.79	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	57,876.89	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	47,943.71	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	152,074.19	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-949,270.74	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	14,792.91	-
<b>减：二、费用</b>		972,956.80	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	450,450.62	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	75,075.14	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	145,814.96	-
4. 交易费用	6.4.7.19	58,514.90	-
5. 利息支出		81,294.58	-
其中：卖出回购金融资产支出		81,294.58	-
6. 税金及附加		897.38	-
7. 其他费用	6.4.7.20	160,909.22	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-439,359.25	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-439,359.25	-

注：本基金于 2017 年 8 月 23 日成立，故无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华鑫荣混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	152,890,958.89	1,107,585.58	153,998,544.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-439,359.25	-439,359.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-96,269,886.46	-1,545,604.98	-97,815,491.44
其中：1.基金申购款	361,270.79	1,256.63	362,527.42
2.基金赎回款	-96,631,157.25	-1,546,861.61	-98,178,018.86

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	56,621,072.43	-877,378.65	55,743,693.78

注：本基金于 2017 年 8 月 23 日成立，故无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗春风	_____ 林婉文	_____ 胡明
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安大华鑫荣混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]844号《关于准予平安大华鑫荣混合型证券投资基金注册的批复》核准，由平安大华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 312,827,378.82 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 822 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 313,011,875.04 份基金份额，其中认购资金利息折合 184,496.22 份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券资产(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融

工具。本基金的投资组合比例为：本基金为混合型基金，本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 40%；持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合财富(总值)指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款利率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	3,976,932.85
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计:	3,976,932.85

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	16,976,650.22	16,067,581.60	-909,068.62	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	38,567,650.00	38,699,000.00	131,350.00
	合计	38,567,650.00	38,699,000.00	131,350.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	55,544,300.22	54,766,581.60	-777,718.62	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	253.60
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,371,538.58
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.45
合计	1,371,792.63

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	15,631.73
银行间市场应付交易费用	495.88
合计	16,127.61

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	137,929.92
合计	137,929.92

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安大华鑫荣 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	21,235,519.55	21,235,519.55
本期申购	201,995.72	201,995.72

本期赎回(以“-”号填列)	-6,480,773.62	-6,480,773.62
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	14,956,741.65	14,956,741.65

金额单位：人民币元

平安大华鑫荣 C		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	131,655,439.34	131,655,439.34
本期申购	159,275.07	159,275.07
本期赎回(以“-”号填列)	-90,150,383.63	-90,150,383.63
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	41,664,330.78	41,664,330.78

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安大华鑫荣 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	187,169.06	10,693.79	197,862.85
本期利润	143,473.29	-408,464.71	-264,991.42
本期基金份额交易产生的变动数	-73,501.45	-29,350.43	-102,851.88
其中：基金申购款	2,721.27	-2,389.57	331.70
基金赎回款	-76,222.72	-26,960.86	-103,183.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	257,140.90	-427,121.35	-169,980.45

单位：人民币元

平安大华鑫荣 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	843,443.71	66,279.02	909,722.73
本期利润	366,438.20	-540,806.03	-174,367.83

本期基金份额交易产生的变动数	-733,588.60	-709,164.50	-1,442,753.10
其中：基金申购款	1,413.45	-488.52	924.93
基金赎回款	-735,002.05	-708,675.98	-1,443,678.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	476,293.31	-1,183,691.51	-707,398.20

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	22,602.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	117.10
其他	42.98
合计	22,762.54

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	22,533,020.50
减：卖出股票成本总额	22,475,143.61
买卖股票差价收入	57,876.89

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	47,943.71
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	47,943.71
----	-----------

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	141,104,220.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	139,087,339.45
减：应收利息总额	1,968,937.74
买卖债券差价收入	47,943.71

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金于本报告期内无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金于本报告期内无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金于本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	152,074.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	152,074.19

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-949,270.74
——股票投资	-1,499,970.19
——债券投资	550,699.45
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-949,270.74

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	14,791.65
基金转换费收入	1.26

合计	14,792.91
----	-----------

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。(注：一个月=30 日)
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注 1 中约定的比例计入基金财产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	55,714.90
银行间市场交易费用	2,800.00
合计	58,514.90

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	99,177.14
其他	600.00
银行间账户维护费	27,000.00
银行费用	4,379.30
合计	160,909.22

#### 6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	450,450.62	-
其中：支付销售机构的客户维护费	329,984.67	-

注：支付基金管理人平安大华的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	75,075.14	-

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华鑫荣 A	平安大华鑫荣 C	合计

平安大华基金管理有限 公司	-	149.14	149.14
平安银行股份有限公司	-	76.39	76.39
平安证券股份有限公司	-	5.82	5.82
中国工商银行股份有限 公司	-	145,308.16	145,308.16
合计	-	145,539.51	145,539.51
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华鑫荣 A	平安大华鑫荣 C	合计

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安大华基金管理有限公司，再由平安大华基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期末未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,976,932.85	22,602.46	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600751	海航科技	2018年1月16日	重大事项	6.49	-	-	15,600	101,621.45	101,244.00	-
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项	7.47	2018年8月20日	7.25	9,800	86,181.84	73,206.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	13.08	-	-	2,200	43,649.00	28,776.00	-
601118	海南橡胶	2018年5月24日	重大事项	6.62	-	-	2,200	13,134.00	14,564.00	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,998,878.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111784227	17 广州农村商业银行 CD161	2018 年 7 月 2 日	95.58	43,000	4,109,940.00
合计				43,000	4,109,940.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制订了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	29,882,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	10,003,000.00	89,776,000.00
合计	10,003,000.00	119,658,000.00

注：以上按短期信用评级的债券投资未评级的债券投资为政策性金融债、超短期融资券。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	28,696,000.00	38,530,000.00
合计	28,696,000.00	38,530,000.00

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的债券。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 3,998,878.00 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.39%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 3976932.85 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,976,932.85	-	-	-	-	-	3,976,932.85
存出保证金	1,046.61	-	-	-	-	-	1,046.61

交易性金融资产	10,003,000.00	19,127,000.00	9,569,000.00	-	-	-16,067,581.60	54,766,581.60
应收利息	-	-	-	-	-	-1,371,792.63	1,371,792.63
应收申购款	-	-	-	-	-	198.10	198.10
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,980,979.46	19,127,000.00	9,569,000.00	-	-	-17,439,572.33	60,116,551.79
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,998,878.00	-	-	-	-	-	3,998,878.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-136,385.94	136,385.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-55,981.35	55,981.35
应付托管费	-	-	-	-	-	-9,330.22	9,330.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-17,048.03	17,048.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	-16,127.61	16,127.61
应付利息	-	-	-	-	-	-1,176.94	1,176.94
其他负债	-	-	-	-	-	-137,929.92	137,929.92
负债总计	3,998,878.00	-	-	-	-	-373,980.01	4,372,858.01
利率敏感度缺口	9,982,101.46	19,127,000.00	9,569,000.00	-	-	-17,065,592.32	55,743,693.78
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,703,047.98	-	-	-	-	-	1,703,047.98
结算备付金	81,586.44	-	-	-	-	-	81,586.44
存出保证金	6,500.86	-	-	-	-	-	6,500.86
交易性金融资产	-	9,759,000.00	148,429,000.00	-	-	-21,099,147.40	179,287,147.40
应收利息	-	-	-	-	-	-1,848,338.39	1,848,338.39
应收申购款	-	-	-	-	-	99,407.11	99,407.11
资产总计	1,791,135.28	9,759,000.00	148,429,000.00	-	-	-23,046,892.90	183,026,028.18
负债							
卖出回购金融资产款	24,648,723.03	-	-	-	-	-	24,648,723.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	-3,935,191.66	3,935,191.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-171,769.76	171,769.76
应付托管费	-	-	-	-	-	-28,628.31	28,628.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-62,510.50	62,510.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	-20,767.34	20,767.34
应付利息	-	-	-	-	-	-39,879.64	39,879.64
其他负债	-	-	-	-	-	-120,013.47	120,013.47
负债总计	24,648,723.03	-	-	-	-	-4,378,760.68	29,027,483.71
利率敏感度缺口	-22,857,587.75	9,759,000.00	148,429,000.00	-	-	-18,668,132.22	153,998,544.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降25个基点	13,226.44	209,581.54
市场利率上升25个基点	-13,210.92	-208,987.70	

**6.4.13.4.2 外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**6.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的40%；持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	16,067,581.60	28.82	21,099,147.40	13.70
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	16,067,581.60	28.82	21,099,147.40	13.70

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

于 2018 年 06 月 30 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****6.4.14.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

**6.4.14.2 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**6.4.14.3 财务报表的批准**

本财务报表已于 2018 年 08 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	16,067,581.60	26.73
	其中：股票	16,067,581.60	26.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,699,000.00	64.37
	其中：债券	38,699,000.00	64.37
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,976,932.85	6.62
8	其他各项资产	1,373,037.34	2.28
9	合计	60,116,551.79	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	14,564.00	0.03
B	采矿业	615,496.00	1.10
C	制造业	8,363,162.00	15.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	162,819.00	0.29
E	建筑业	491,801.40	0.88
F	批发和零售业	1,137,280.00	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	867,655.00	1.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	120,554.00	0.22
J	金融业	2,454,868.00	4.40
K	房地产业	801,028.00	1.44

L	租赁和商务服务业	537,228.40	0.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	328,907.80	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	172,218.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	16,067,581.60	28.82

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600285	羚锐制药	207,000	1,844,370.00	3.31
2	600030	中信证券	40,000	662,800.00	1.19
3	600036	招商银行	18,900	499,716.00	0.90
4	600028	中国石化	68,200	442,618.00	0.79
5	601939	建设银行	62,900	411,995.00	0.74
6	600993	马应龙	24,000	408,240.00	0.73
7	000333	美的集团	7,500	391,650.00	0.70
8	600048	保利地产	32,100	391,620.00	0.70
9	002142	宁波银行	23,800	387,702.00	0.70
10	000910	大亚圣象	21,000	354,900.00	0.64
11	002271	东方雨虹	20,000	340,200.00	0.61
12	000501	鄂武商A	26,000	319,540.00	0.57
13	601601	中国太保	9,400	299,390.00	0.54
14	603313	梦百合	13,000	252,850.00	0.45
15	600309	万华化学	5,400	245,268.00	0.44
16	000089	深圳机场	32,000	244,800.00	0.44
17	600261	阳光照明	60,000	225,600.00	0.40
18	603055	台华新材	15,000	221,250.00	0.40
19	601668	中国建筑	37,240	203,330.40	0.36
20	300285	国瓷材料	10,000	199,400.00	0.36

21	600138	中青旅	10,000	199,300.00	0.36
22	000858	五粮液	2,600	197,600.00	0.35
23	600585	海螺水泥	5,400	180,792.00	0.32
24	002258	利尔化学	9,000	174,240.00	0.31
25	600409	三友化工	20,000	172,200.00	0.31
26	603686	龙马环卫	7,000	171,080.00	0.31
27	002139	拓邦股份	30,000	170,700.00	0.31
28	002705	新宝股份	17,000	166,090.00	0.30
29	600897	厦门空港	8,000	164,960.00	0.30
30	002078	太阳纸业	16,000	155,040.00	0.28
31	001979	招商蛇口	8,000	152,400.00	0.27
32	002831	裕同科技	3,000	150,000.00	0.27
33	600612	老凤祥	4,000	143,760.00	0.26
34	600176	中国巨石	14,000	143,220.00	0.26
35	601688	华泰证券	8,900	133,233.00	0.24
36	600019	宝钢股份	16,400	127,756.00	0.23
37	002027	分众传媒	13,320	127,472.40	0.23
38	300596	利安隆	5,000	122,500.00	0.22
39	600350	山东高速	30,000	121,500.00	0.22
40	603818	曲美家居	10,000	117,600.00	0.21
41	600054	黄山旅游	10,000	116,500.00	0.21
42	300193	佳士科技	20,000	115,400.00	0.21
43	600790	轻纺城	30,000	107,400.00	0.19
44	002585	双星新材	20,000	106,800.00	0.19
45	601900	南方传媒	11,000	103,840.00	0.19
46	601888	中国国旅	1,600	103,056.00	0.18
47	600690	青岛海尔	5,300	102,078.00	0.18
48	002003	伟星股份	12,000	101,640.00	0.18
49	600751	海航科技	15,600	101,244.00	0.18
50	600114	东睦股份	10,000	97,700.00	0.18
51	601155	新城控股	3,100	96,007.00	0.17
52	601766	中国中车	12,400	95,480.00	0.17
53	002867	周大生	3,000	94,470.00	0.17
54	002567	唐人神	20,000	90,600.00	0.16
55	601636	旗滨集团	20,000	89,000.00	0.16
56	600009	上海机场	1,600	88,768.00	0.16
57	002242	九阳股份	5,000	88,450.00	0.16
58	000888	峨眉山A	10,000	87,900.00	0.16
59	002024	苏宁易购	6,000	84,480.00	0.15

60	002713	东易日盛	4,000	82,200.00	0.15
61	600383	金地集团	7,900	80,501.00	0.14
62	000402	金融街	10,000	80,500.00	0.14
63	601515	东风股份	10,000	77,200.00	0.14
64	002043	兔宝宝	10,000	76,600.00	0.14
65	601088	中国神华	3,700	73,778.00	0.13
66	601390	中国中铁	9,800	73,206.00	0.13
67	000429	粤高速A	10,000	72,200.00	0.13
68	002236	大华股份	3,200	72,160.00	0.13
69	600741	华域汽车	3,000	71,160.00	0.13
70	601186	中国铁建	8,000	68,960.00	0.12
71	002521	齐峰新材	10,000	65,200.00	0.12
72	300296	利亚德	5,000	64,400.00	0.12
73	000581	威孚高科	2,800	61,908.00	0.11
74	601225	陕西煤业	7,400	60,828.00	0.11
75	601336	新华保险	1,400	60,032.00	0.11
76	000978	桂林旅游	10,000	59,300.00	0.11
77	601566	九牧王	4,000	59,000.00	0.11
78	600570	恒生电子	1,100	58,245.00	0.10
79	002460	赣锋锂业	1,500	57,870.00	0.10
80	603167	渤海轮渡	6,000	57,780.00	0.10
81	000887	中鼎股份	3,900	56,199.00	0.10
82	000898	鞍钢股份	10,000	55,700.00	0.10
83	600066	宇通客车	2,900	55,651.00	0.10
84	002701	奥瑞金	10,000	54,600.00	0.10
85	601607	上海医药	2,100	50,190.00	0.09
86	600029	南方航空	5,900	49,855.00	0.09
87	600308	华泰股份	10,000	49,800.00	0.09
88	002466	天齐锂业	1,000	49,590.00	0.09
89	600062	华润双鹤	2,000	49,100.00	0.09
90	300144	宋城演艺	2,000	47,000.00	0.08
91	000543	皖能电力	10,000	44,100.00	0.08
92	600795	国电电力	16,800	44,016.00	0.08
93	000759	中百集团	6,000	43,260.00	0.08
94	300070	碧水源	3,100	43,183.00	0.08
95	600027	华电国际	10,000	39,200.00	0.07
96	002543	万和电气	2,000	38,640.00	0.07
97	600547	山东黄金	1,600	38,272.00	0.07
98	600332	白云山	1,000	38,050.00	0.07

99	600703	三安光电	1,900	36,518.00	0.07
100	600452	涪陵电力	1,300	35,503.00	0.06
101	600068	葛洲坝	4,900	35,329.00	0.06
102	002065	东华软件	4,000	34,400.00	0.06
103	002007	华兰生物	1,000	32,160.00	0.06
104	600893	航发动力	1,400	31,248.00	0.06
105	601919	中远海控	6,300	30,996.00	0.06
106	002310	东方园林	2,200	28,776.00	0.05
107	002624	完美世界	900	27,909.00	0.05
108	601333	广深铁路	5,600	23,800.00	0.04
109	000826	启迪桑德	1,260	22,024.80	0.04
110	600153	建发股份	2,400	21,576.00	0.04
111	300251	光线传媒	2,100	21,378.00	0.04
112	002470	金正大	2,600	17,888.00	0.03
113	601118	海南橡胶	2,200	14,564.00	0.03
114	002385	大北农	3,500	14,455.00	0.03
115	600827	百联股份	1,400	14,280.00	0.03
116	601872	招商轮船	3,600	12,996.00	0.02
117	600372	中航电子	900	11,754.00	0.02
118	000959	首钢股份	2,700	11,097.00	0.02

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600285	羚锐制药	1,857,723.00	1.21
2	600993	马应龙	429,494.00	0.28
3	002271	东方雨虹	406,055.00	0.26
4	600030	中信证券	403,902.00	0.26
5	000910	大亚圣象	399,128.00	0.26
6	600016	民生银行	362,100.00	0.24
7	000501	鄂武商 A	354,468.00	0.23
8	601328	交通银行	322,704.00	0.21
9	000596	古井贡酒	284,244.00	0.18
10	603313	梦百合	283,577.00	0.18
11	600837	海通证券	270,228.00	0.18

12	600000	浦发银行	266,463.00	0.17
13	000089	深圳机场	247,674.00	0.16
14	603055	台华新材	238,586.00	0.15
15	600261	阳光照明	226,401.00	0.15
16	600138	中青旅	209,937.00	0.14
17	300285	国瓷材料	194,438.00	0.13
18	002139	拓邦股份	186,382.00	0.12
19	600409	三友化工	184,454.00	0.12
20	002258	利尔化学	176,543.00	0.11

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000338	潍柴动力	621,676.00	0.40
2	600104	上汽集团	526,633.49	0.34
3	600519	贵州茅台	471,210.00	0.31
4	000651	格力电器	457,480.00	0.30
5	601288	农业银行	450,578.00	0.29
6	000596	古井贡酒	423,488.00	0.27
7	601166	兴业银行	396,180.00	0.26
8	601628	中国人寿	395,759.00	0.26
9	600460	士兰微	384,553.00	0.25
10	600887	伊利股份	338,794.00	0.22
11	600958	东方证券	336,219.00	0.22
12	600016	民生银行	326,742.00	0.21
13	600276	恒瑞医药	309,900.00	0.20
14	600900	长江电力	307,524.30	0.20
15	601328	交通银行	300,792.00	0.20
16	002415	海康威视	289,749.93	0.19
17	600837	海通证券	286,667.00	0.19
18	600606	绿地控股	262,084.00	0.17
19	002001	新和成	251,134.00	0.16
20	000002	万科A	247,000.00	0.16

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	18,943,548.00
卖出股票收入（成交）总额	22,533,020.50

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,003,000.00	17.94
	其中：政策性金融债	10,003,000.00	17.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	28,696,000.00	51.48
9	其他	-	-
10	合计	38,699,000.00	69.42

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	170410	17 农发 10	100,000	10,003,000.00	17.94
2	111714268	17 江苏银行 CD268	100,000	9,569,000.00	17.17
2	111787087	17 杭州银行 CD214	100,000	9,569,000.00	17.17
3	111784227	17 广州农村商业银行 CD161	100,000	9,558,000.00	17.15

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本组合投资的前十名证券之一招商银行，于 2018 年 2 月 12 日被中国银监会公开处罚，主要

违法违规事实包括：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。中国银监会决定罚款招商银行 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,046.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,371,792.63
5	应收申购款	198.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,373,037.34

#### **7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

#### **7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
平安大华鑫荣 A	209	71,563.36	-	0.00%	14,956,741.65	100.00%
平安大华鑫荣 C	228	182,738.29	-	0.00%	41,664,330.78	100.00%
合计	433	130,764.60	-	0.00%	56,621,072.43	100.00%

上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安大华鑫荣 A	0.00	0.0000%
	平安大华鑫荣 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安大华鑫荣 A	0
	平安大华鑫荣 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华鑫荣 A	0
	平安大华鑫荣 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安大华鑫荣 A	平安大华鑫荣 C
基金合同生效日（2017 年 8 月 23 日）基金份额总额	24,779,024.09	288,232,850.95
本报告期期初基金份额总额	21,235,519.55	131,655,439.34
本报告期基金总申购份额	201,995.72	159,275.07
减：本报告期基金总赎回份额	6,480,773.62	90,150,383.63
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	14,956,741.65	41,664,330.78

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
太平洋证券	2	31,072,341.44	74.92%	22,102.22	74.92%	-
爱建证券	2	7,947,685.06	19.16%	5,653.21	19.16%	新增
海通证券	4	2,065,169.00	4.98%	1,469.05	4.98%	-
中泰证券	2	391,373.00	0.94%	278.31	0.94%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	新增
新时代证券	2	-	-	-	-	新增
中信建投	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
太平洋证券	-	-	9,000,000.00	100.00%	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于平安大华鑫荣混合债券型证券投资基金基金经理变更公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年1月10日
2	关于旗下部分基金新增南京证券为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年1月12日
3	平安大华鑫荣混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年1月19日
4	关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年2月6日
5	平安大华鑫荣混合型证券投资基金修改基金合同的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年3月24日
6	平安大华基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年3月26日
7	平安大华鑫荣混合型证券投资基金 2017 年年度报告以及摘要	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年3月29日
8	关于旗下部分基金新增海银基金为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年4月16日
9	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年4月19日
10	平安大华鑫荣混合型证券投资基金 2018 年 1 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年4月20日
11	关于旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为销售机构公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年5月29日
12	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年6月12日
13	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年6月20日
14	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018年6月21日

15	关于旗下基金所持东方园林 (代码 002310)、上海电气(代 码 601727) 估值调整的公告	公司网站、证券时 报、上海证券报	2018 年 6 月 26 日
----	---	---------------------	-----------------

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华鑫荣混合型证券投资基金的文件；
- 2、平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金合同；
- 3、平安大华鑫荣混合型证券投资基金托管协议；
- 4、平安大华鑫荣混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安大华基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内平安大华鑫荣混合型证券投资基金公告的各项原稿。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>

平安大华基金管理有限公司

2018 年 8 月 27 日